



Backtest #30798 · TSLA · EVO\_GG1RSISNIP\_v60

|        |        |          |              |
|--------|--------|----------|--------------|
| ROI    | Sharpe | Win Rate | Max Drawdown |
| -3.15% | -0.09  | 0.0%     | -15.69%      |

EQUITY CURVE202 sessions · starting at \$10000.00



ANALYST NOTE

Hera local LLM

La estrategia EVO\_GG1RSISNIP\_v60 presentó un rendimiento negativo con una ROI de -3.15% y una tasa de ganancia del 0.0%, lo que indica una falta de capacidad de generación de ganancias. El Sharpe ratio negativo de -0.09 sugiere que el riesgo no fue compensado adecuadamente, y el máximo drawdown del 15.69% revela una alta volatilidad. Con solo una operación, los resultados carecen de confianza estadística, y se necesita más datos para evaluar su viabilidad. Se recomienda aumentar el número de muestras de backtesting a al menos 20 operaciones para obtener una evaluación más robusta antes de considerar una modificación del modelo.

ADDITIONAL METRICS

|                 |            |
|-----------------|------------|
| CAGR            | -3.15%     |
| Sortino Ratio   | -0.05      |
| Turnover        | 1.97x      |
| Total Trades    | 1          |
| Initial Capital | \$10000.00 |
| Final Capital   | \$9685.03  |